

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	1
2.1 基金基本情况	1
2.2 基金产品说明	1
2.3 基金管理人和基金托管人	2
2.4 信息披露方式	3
2.5 其他相关资料	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	3
3.1 主要会计数据和财务指标	3
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	54
7.1 期末基金资产组合情况	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	67
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	67
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	68
§8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	70

§9 开放式基金份额变动	70
§10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	72
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	72
10.8 其他重大事件	75
§11 影响投资者决策的其他重要信息	76
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§12 备查文件目录	76
12.1 备查文件目录	76
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金				
基金简称	博时沪深 300 指数				
基金主代码	050002				
交易代码	050002				
基金运作方式	契约型开放式				
基金合同生效日	2003 年 8 月 26 日				
基金管理人	博时基金管理有限公司				
基金托管人	中国建设银行股份有限公司				
报告期末基金份额总额	2,486,587,281.51 份				
基金合同存续期	不定期				
下属分级基金的基金简称	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I
下属分级基金的交易代码	050002	002385	960022	022922	024186
报告期末下属分级基金的份额总额	2,096,421,753.39 份	375,067,416.02 份	-份	14,920,209.23 份	177,902.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国资本市场的长期增长。本基金将以对标的指数的长期投资为基本原则，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在 95%以上，并保持年跟踪误差在 4% 以下。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。即调整其股票资产比例为 95% 以内，现金或者到期日在一年以内的政府债券比例不低于 5%。1. 资产配置原则本基金

	以追求基准指数长期增长的稳定收益为宗旨，采用自上而下的两层次资产配置策略，首先确定基金资产在不同资产类别之间的配置比例，再进一步确定各资产类别中不同证券的配置比例，以完全复制的方法进行组合构建。2. 资产配置策略本基金为被动式指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。3. 股票资产配置策略本基金股票资产投资以沪深 300 指数为标的指数，原则上采用完全复制标的指数的方法，首先按照标的指数中的行业权重为基准权重，确定行业配置比例；再进一步根据各行业中的个股基准权重，确定行业内的个股配置比例。本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。4、投资组合调整原则本基金的股票投资为完全复制的被动式指数投资，债券投资为流动性风险约束下的被动式投资，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。
业绩比较基准	95%的沪深 300 指数加 5%的银行同业存款利率。
风险收益特征	由于本基金采用复制的指数化投资方法，基金净值增长率与标的指数增长率间相偏离的风险尤为突出。本基金将严格执行风险管理程序，最大程度地运用数量化风险管理手段，以偏离度、跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时跟踪控制与管理。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	王小飞
	联系电话	0755-83169999	021-60637103
	电子邮箱	service@bosera.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	021-60637228
传真		0755-83195140	021-60635778
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区	北京市西城区金融大街 25 号

	益田路 5999 号基金大厦 21 层	
办公地址	广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518040	100033
法定代表人	张东	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.bosera.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）				
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I
本期已实现收益	302,974,063.44	46,097,874.93	-	1,858,331.68	15,400.69
本期利润	445,486,121.46	72,593,800.63	-	2,891,103.83	44,516.35
加权平均基金份额本期利润	0.1980	0.2003	-	0.2139	0.2871
本期加权平均净值利润率	9.72%	10.10%	-	10.41%	14.11%

本期基金份额净值增长率	10.14%	9.92%	-	10.47%	10.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)				
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I
期末可供分配利润	2,438,757,416.29	347,576,961.75	-	17,629,959.61	206,198.96
期末可供分配基金份额利润	1.1633	0.9267	-	1.1816	1.1591
期末基金资产净值	4,535,179,169.68	789,920,100.70	-	32,550,168.84	384,101.83
期末基金份额净值	2.1633	2.1061	-	2.1816	2.1591
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)				
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I
基金份额累计净值增长率	619.62%	123.21%	1.76%	34.30%	35.60%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时沪深 300 指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.58%	1.19%	11.30%	1.19%	1.28%	0.00%
过去六个月	10.14%	1.07%	7.20%	1.07%	2.94%	0.00%
过去一年	28.75%	0.96%	25.13%	0.97%	3.62%	-0.01%
过去三年	41.19%	1.06%	28.26%	1.06%	12.93%	0.00%

过去五年	9.65%	1.06%	-4.02%	1.06%	13.67%	0.00%
过去七年	55.11%	1.10%	29.35%	1.11%	25.76%	-0.01%
过去十年	108.95%	1.09%	55.89%	1.09%	53.06%	0.00%
自基金合同生效起至今	619.62%	1.46%	289.14%	1.47%	330.48%	-0.01%

博时沪深 300 指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.47%	1.19%	11.30%	1.19%	1.17%	0.00%
过去六个月	9.92%	1.07%	7.20%	1.07%	2.72%	0.00%
过去一年	28.24%	0.96%	25.13%	0.97%	3.11%	-0.01%
过去三年	39.50%	1.06%	28.26%	1.06%	11.24%	0.00%
过去五年	7.48%	1.06%	-4.02%	1.06%	11.50%	0.00%
过去七年	50.84%	1.10%	29.35%	1.11%	21.49%	-0.01%
过去十年	100.73%	1.09%	55.89%	1.09%	44.84%	0.00%
自基金合同生效起至今	123.21%	1.10%	66.72%	1.10%	56.49%	0.00%

注：自 2016 年 1 月 27 日起，本基金新增 C 类份额。

博时沪深 300 指数 R

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	1.76%	0.97%	-3.67%	0.95%	5.43%	0.02%

注：自 2016 年 9 月 8 日起，本基金新增 R 类份额；自 2018 年 11 月 15 日起，本基金份额全部赎回，故沪深 300R 类份额数据截止日为 2018 年 11 月 14 日。

博时沪深 300 指数 Y

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.74%	1.19%	11.30%	1.19%	1.44%	0.00%
过去六个月	10.47%	1.07%	7.20%	1.07%	3.27%	0.00%
过去一年	29.52%	0.96%	25.13%	0.97%	4.39%	-0.01%
自基金合同生效起至今	34.30%	0.97%	25.26%	0.96%	9.04%	0.01%

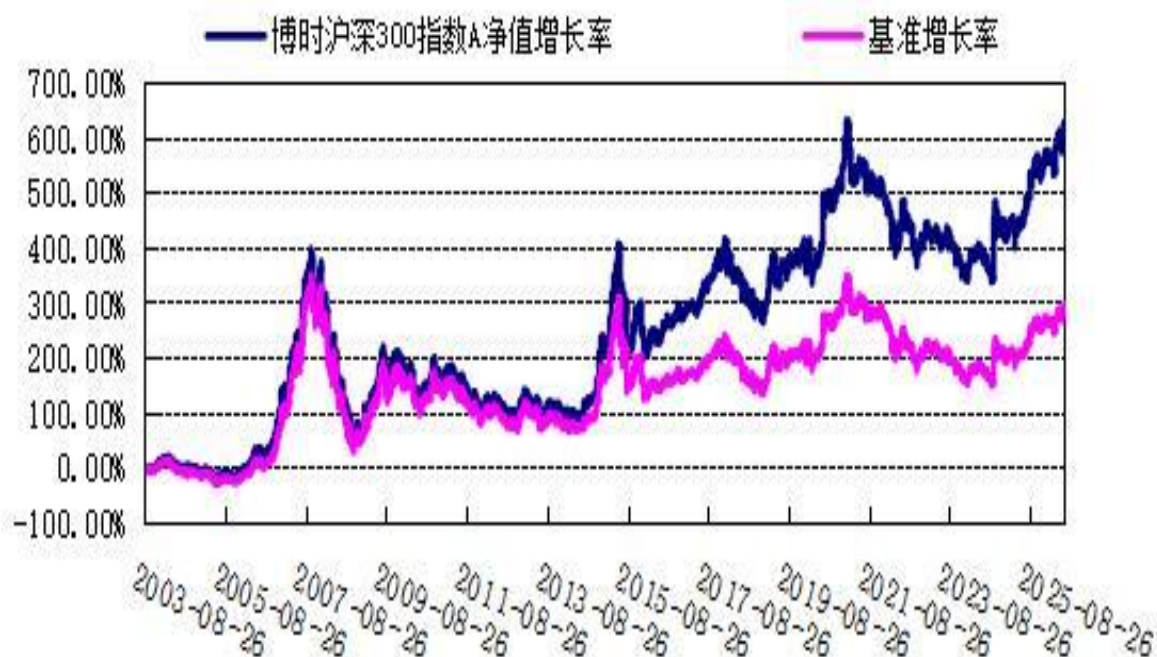
博时沪深 300 指数 I

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.55%	1.19%	11.30%	1.19%	1.25%	0.00%
过去六个月	10.09%	1.07%	7.20%	1.07%	2.89%	0.00%
过去一年	28.61%	0.96%	25.13%	0.97%	3.48%	-0.01%
自基金合同生效起至今	35.60%	0.92%	30.20%	0.92%	5.40%	0.00%

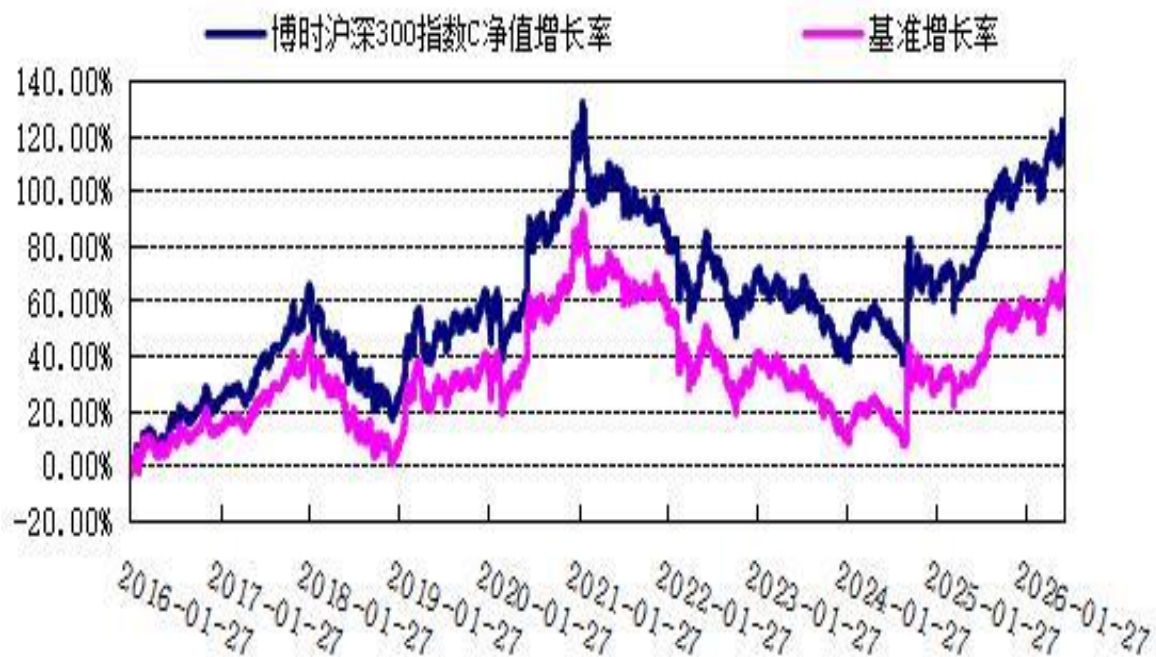
注：自基金成立至 2004 年 12 月 31 日，本基金业绩比较基准为新华富时 A200 复合指数；自 2005 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日，本基金业绩比较基准为 95%的新华富时中国 A200 指数 + 5%的银行同业存款利率；自 2008 年 1 月 1 日起，本基金业绩比较基准为 95%的沪深 300 指数+5%的银行同业存款利率。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

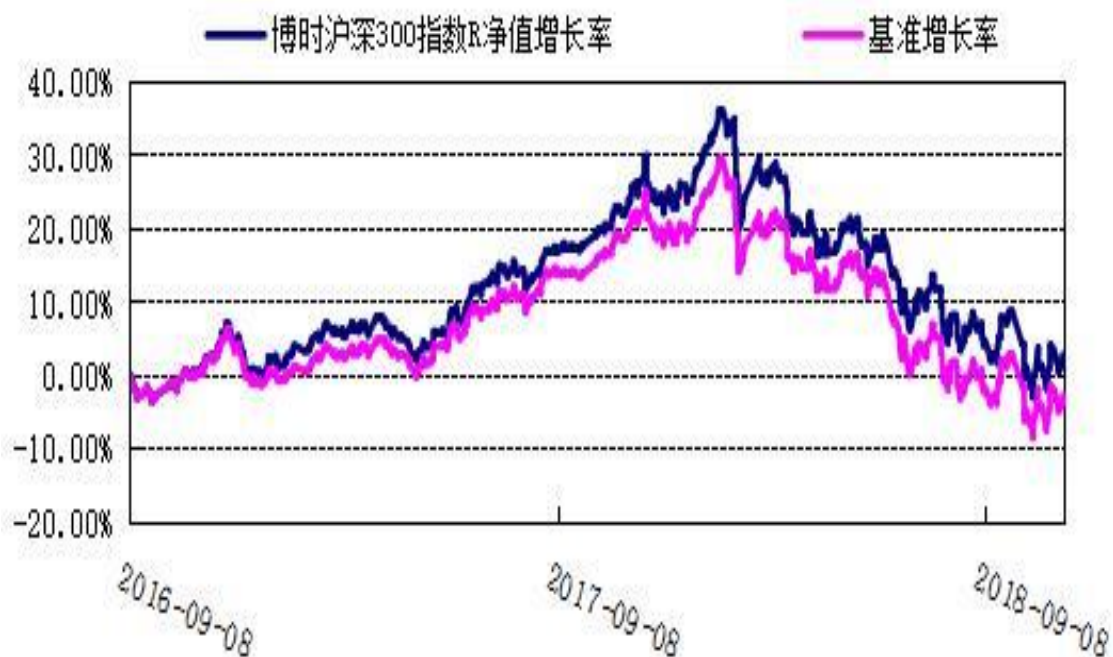
博时沪深 300 指数 A



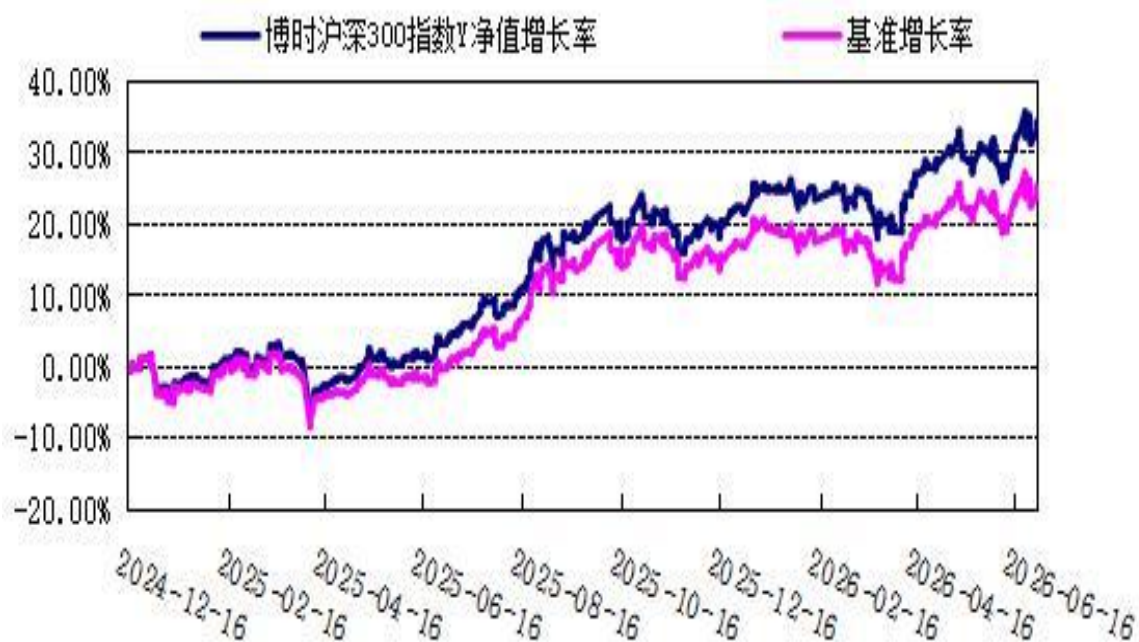
博时沪深 300 指数 C



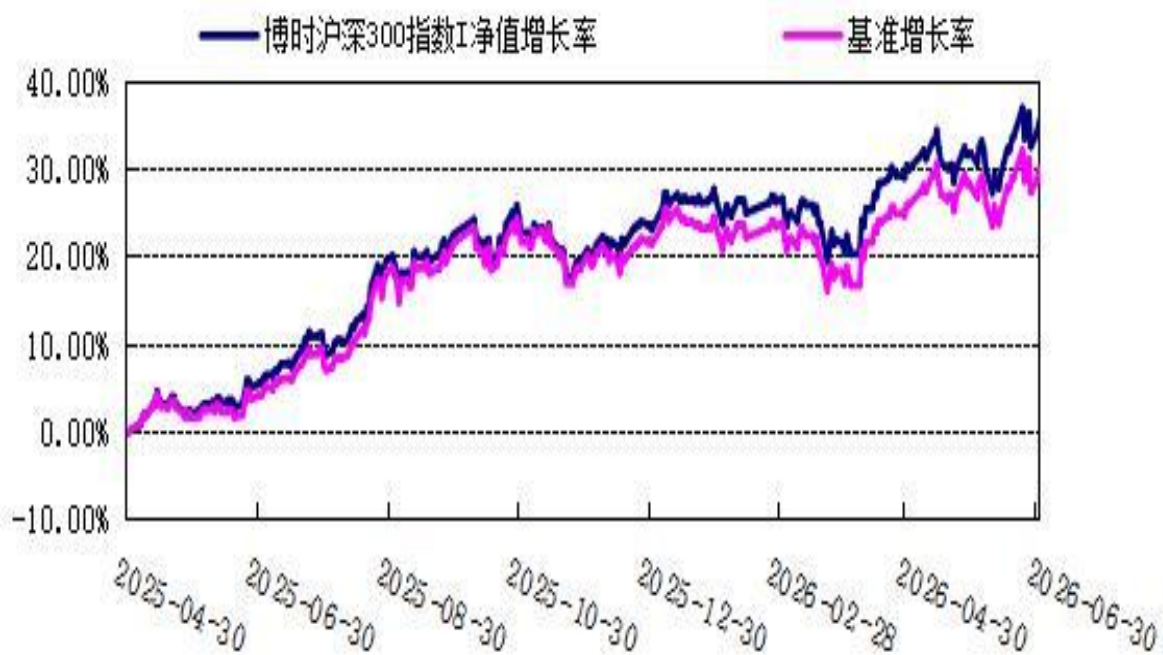
博时沪深 300 指数 R



博时沪深 300 指数 Y



博时沪深 300 指数 I



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2026 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 404 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 17,353 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,993 亿元人民币，累计分红逾 2,312 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨振建	基金经理	2020-12-23	-	12.8	杨振建先生，博士。2013 年至 2015 年在中证指数有限公司工作（期间借调中国证监会任产品审核员）。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理助理、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日-2021 年 7 月 16 日)、博时中证 A500 指数型证券投资基金(2024 年 10 月 30 日-2024 年 11 月 28 日)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 5 月 14 日-2026 年 5 月 21 日)的基金经理。现任博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 9 月 20 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019 年 11 月

					13 日—至今)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 3 月 3 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 7 月 27 日—至今)、博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 11 月 2 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 4 月 16 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 7 月 19 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 11 月 21 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2024 年 11 月 27 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 11 月 29 日—至今)、博时中证 800 指数增强型证券投资基金(2025 年 9 月 2 日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2025 年 11 月 3 日—至今)的基金经理。
桂征辉	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2015-07-21	-	16.8	桂征辉先生，硕士。2006 年起先后在松下电器、美国在线公司、百度公司工作。2009 年加入博时基金管理有限公司。历任高级程序员、高级研究员、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2018 年 6 月 12 日-2019 年 9 月 5 日)、博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2017 年 9 月 26 日-2020 年 12 月 23

					日)、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2016 年 5 月 20 日-2021 年 7 月 16 日)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2015 年 7 月 21 日-2024 年 7 月 5 日)、博时中证 A50 指数型发起式证券投资基金(2024 年 8 月 27 日-2025 年 5 月 29 日)、博时恒享债券型证券投资基金(2023 年 9 月 26 日-2026 年 1 月 23 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2015 年 7 月 21 日—至今)、博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日—至今)、博时中证 1000 指数增强型证券投资基金(2023 年 4 月 13 日—至今)、博时恒鑫稳健一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2025 年 5 月 30 日—至今)、博时中证 A500 指数增强型证券投资基金(2025 年 8 月 25 日—至今)的基金经理,兼任投资经理。
--	--	--	--	--	--

注:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
桂征辉	公募基金	6	6,498,329,658.68	2015-07-21
	私募资产管理计划	3	1,536,802,634.65	2025-02-28
	其他组合	-	-	-
	合计	9	8,035,132,293.33	

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 18 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，2026 年上半年 A 股市场呈现“震荡上行、结构分化”的态势，主要指数稳步收涨，市场活力显著增强，行情主线清晰，科技成长板块领涨，人工智能、算力半导体等新质生产力领域表现强劲，市场“含科量”显著提升，上证指数上半年收于 4094 点。海外在地缘局势逐步缓和之后，全球多数权益资产在年初波动后逐步回稳。本基金利用数量化手段对组合进行管理，严格控制与指数跟踪偏离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 2.1633 元，份额累计净值为 4.2240 元，本基金 C 类基金份额净值为 2.1061 元，份额累计净值为 2.1469 元，本基金 I 类基金份额净值为 2.1591 元，份额累计净值为 2.1689 元，本基金 R 类基金期末无份额，本基金 Y 类基金份额净值为 2.1816 元，份额累计净值为 2.2085 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 10.14%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 9.92%，本基金 I 类基金份额净值增长率为 10.09%，本基金 Y 类基金份额净值增长率为 10.47%，同期业绩基准增长率为 7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年在更加积极有为的宏观政策支持下，中国经济运行总体平稳，出口保持了韧性。宏观政策明确实施“更加积极的财政政策”和“适度宽松的货币政策”，为经济回升向好提供了有力支撑。财政政策保持适度支出强度、持续发行超长期特别国债并支持“两重”“两新”建设，货币政策保持流动性合理充裕，推动社会综合融资成本稳中有降。在此背景下，市场流动性整体充裕，科技成长板块表现相对突出，资源品、红利等板块整体表现相对偏弱。展望下半年，从盈利预期角度看，A 股市场预计将在盈利驱动与政策支持下，市场驱动力将从估值扩张转向企业盈利改善预期。宏观基本面预计在“十五五”开局之年的产业政策与流动性宽松环境中逐步企稳。配置上建议关注上市公司业绩兑现能力与结构性机会的平衡。沪深 300 作为 A 股核心资产的重要标的，当前成份股的估值水平处于历史相对均衡的位置，值得长期配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于 2026 年 1 月 9 日发布公告，以 2025 年 12 月 31 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0980 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0810 元人民币，本基金 I 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0980 元人民币，本基金 Y 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0990 元人民币。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	124,557,541.84	345,808,405.24
结算备付金		5,056,398.82	3,322,994.26
存出保证金		360,171.61	390,642.62
交易性金融资产	6.4.6.2	5,247,199,185.71	5,234,073,806.72
其中：股票投资		5,045,902,802.15	5,234,073,806.72
基金投资		-	-
债券投资		201,296,383.56	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		30,669.72	36,261,457.04
应收股利		-	-
应收申购款		4,065,728.43	3,997,712.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-
资产总计		5,381,269,696.13	5,623,855,017.98
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日

负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		73,815.34	36,285,569.69
应付赎回款		16,586,175.34	24,381,907.58
应付管理人报酬		4,165,778.63	4,620,997.01
应付托管费		850,158.81	943,060.65
应付销售服务费		221,845.32	269,196.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,579.58	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	1,333,802.06	1,528,055.78
负债合计		23,236,155.08	68,028,787.51
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	2,486,587,281.51	2,825,333,344.32
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	2,871,446,259.54	2,730,492,886.15
净资产合计		5,358,033,541.05	5,555,826,230.47
负债和净资产总计		5,381,269,696.13	5,623,855,017.98

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,486,587,281.51 份。其中 A 类基金份额净值 2.1633 元，基金份额总额 2,096,421,753.39 份；C 类基金份额净值 2.1061 元，基金份额总额 375,067,416.02 份；无 R 类基金份额；Y 类基金份额净值 2.1816 元，基金份额总额 14,920,209.23 份；I 类基金份额净值 2.1591 元，基金份额总额 177,902.87 份。

6.2 利润表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026年1月1日至2026 年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年 6月30日
一、营业总收入		553,688,628.29	232,505,399.52
1.利息收入		540,951.15	659,710.03
其中：存款利息收入	6.4.6.9	540,951.15	659,710.03
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		382,430,900.02	323,217,440.68
其中：股票投资收益	6.4.6.10	327,799,295.50	248,800,886.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	136,294.65	67,570.55
资产支持证券投资收益	6.4.6.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.13	-	-
股利收益	6.4.6.14	54,495,309.87	74,348,983.84
以摊余成本计量的金融资产终止确 认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填 列）	6.4.6.15	170,069,871.53	-91,814,610.81

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	646,905.59	442,859.62
减：二、营业总支出		32,673,086.02	37,881,301.96
1. 管理人报酬		25,817,368.21	29,340,531.69
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		5,268,850.63	5,987,863.64
3. 销售服务费		1,428,294.96	2,430,126.67
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		31,665.00	-
其中：卖出回购金融资产支出		31,665.00	-
6. 信用减值损失	6.4.6.17	-	-
7. 税金及附加		490.67	0.12
8. 其他费用	6.4.6.18	126,416.55	122,779.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		521,015,542.27	194,624,097.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		521,015,542.27	194,624,097.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		521,015,542.27	194,624,097.56

6.3 净资产变动表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026年1月1日至2026年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	2,825,333,344.32	-	2,730,492,886.15	5,555,826,230.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,825,333,344.32	-	2,730,492,886.15	5,555,826,230.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-338,746,062.81	-	140,953,373.39	-197,792,689.42
（一）、综合收益总额	-	-	521,015,542.27	521,015,542.27
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-338,746,062.81	-	-353,603,085.58	-692,349,148.39
其中：1.基金申购款	423,796,155.42	-	432,467,166.43	856,263,321.85
2.基金赎回款	-762,542,218.23	-	-786,070,252.01	-1,548,612,470.24
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-26,459,083.30	-26,459,083.30
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,486,587,281.51	-	2,871,446,259.54	5,358,033,541.05

项目	上年度可比期间			
	2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,798,379,473.22	-	2,446,443,976.08	6,244,823,449.30
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,798,379,473.22	-	2,446,443,976.08	6,244,823,449.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-311,425,702.66	-	-72,451,659.90	-383,877,362.56
（一）、综合收益总额	-	-	194,624,097.56	194,624,097.56
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-311,425,702.66	-	-204,311,608.96	-515,737,311.62
其中：1.基金申购款	324,340,510.88	-	193,745,984.89	518,086,495.77
2.基金赎回款	-635,766,213.54	-	-398,057,593.85	-1,033,823,807.39
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-62,764,148.50	-62,764,148.50

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,486,953,770.56	-	2,373,992,316.18	5,860,946,086.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张东，主管会计工作负责人：吴慧峰，会计机构负责人：陈子成

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（原名为博时裕富证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2003]第 83 号《关于同意博时裕富证券投资基金设立的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《博时裕富证券投资基金基金契约》（后更名为《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》）发起，并于 2003 年 8 月 26 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,122,784,859.66 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字（2003）第 107 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人于 2010 年 1 月 29 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时裕富证券投资基金更名的公告》，为使本基金名称能够充分体现本基金作为指数型基金的产品特征，本基金于 2010 年 1 月 29 日起更名为“博时裕富沪深 300 指数证券投资基金”。

基金根据是否允许投资者通过个人养老金账户投资本基金、是否收取销售服务费、是否在中国内地市场销售将基金份额分为 A 类基金份额、C 类基金份额、I 类基金份额、Y 类基金份额和 R 类基金份额。本基金自 2016 年 1 月 26 日起增加 C 类基金份额和 R 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额；自 2024 年 12 月 13 日起增加 Y 类基金份额；自 2025 年 4 月 29 日起增加 I 类基金份额。A 类基金份额在中国内地市场销售，投资者认购、申购时收取前端认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用；C 类/I 类基金份额在中国内地市场销售，从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用和赎回费用；Y 类基金份额通过个人养老金账户投资，不从本类别基金

资产中计提销售服务费；R 类基金份额在中国香港市场销售，在赎回时依据固定赎回费率收取赎回费用。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金将主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数成份股及其备选成份股（含存托凭证）、新股及存托凭证（IPO 或增发）以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于股票（含存托凭证）的比例在基金资产总值的 95% 以内；现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

本基金标的指数使用费由基金管理人博时基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制

试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对于内地投资者持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向该内地基金分配利息时按照 7% 的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10% 的税率代扣代缴所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

（4）基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

（5）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
活期存款	124,557,541.84
等于：本金	124,545,509.52
加：应计利息	12,032.32
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	124,557,541.84

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2026年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		4,269,676,318.12	-	5,045,902,802.15	776,226,484.03
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	200,163,757.00	1,116,383.56	201,296,383.56	16,243.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	200,163,757.00	1,116,383.56	201,296,383.56	16,243.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,469,840,075.12	1,116,383.56	5,247,199,185.71	776,242,727.03

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他资产

无余额。

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	13,433.77
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	959,906.01
其中：交易所市场	959,906.01
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	1,823.93
预提费用	108,638.35
合计	1,333,802.06

6.4.6.7 实收基金

博时沪深 300 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	2,406,524,883.99	2,406,524,883.99
本期申购	181,344,366.43	181,344,366.43
本期赎回（以“-”号填列）	-491,447,497.03	-491,447,497.03
本期末	2,096,421,753.39	2,096,421,753.39

博时沪深 300 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	409,498,837.25	409,498,837.25
本期申购	232,915,674.66	232,915,674.66
本期赎回（以“-”号填列）	-267,347,095.89	-267,347,095.89
本期末	375,067,416.02	375,067,416.02

博时沪深 300 指数 Y

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	9,212,559.89	9,212,559.89
本期申购	9,115,821.23	9,115,821.23
本期赎回（以“-”号填列）	-3,408,171.89	-3,408,171.89
本期末	14,920,209.23	14,920,209.23

博时沪深 300 指数 I

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	97,063.19	97,063.19
本期申购	420,293.10	420,293.10
本期赎回（以“-”号填列）	-339,453.42	-339,453.42
本期末	177,902.87	177,902.87

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额(如适用)。

6.4.6.8 未分配利润

博时沪深 300 指数 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,327,520,804.55	-984,485,846.52	2,343,034,958.03
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	3,327,520,804.55	-984,485,846.52	2,343,034,958.03
本期利润	302,974,063.44	142,512,058.02	445,486,121.46
本期基金份额交易产生的变动数	-448,220,798.03	121,682,249.14	-326,538,548.89
其中：基金申购款	261,404,352.08	-73,897,055.86	187,507,296.22
基金赎回款	-709,625,150.11	195,579,305.00	-514,045,845.11
本期已分配利润	-23,225,114.31	-	-23,225,114.31
本期末	3,159,048,955.65	-720,291,539.36	2,438,757,416.29

博时沪深 300 指数 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	330,945,205.05	47,348,530.29	378,293,735.34
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	330,945,205.05	47,348,530.29	378,293,735.34
本期利润	46,097,874.93	26,495,925.70	72,593,800.63
本期基金份额交易产生的变动数	-26,334,238.21	-6,568,733.06	-32,902,971.27
其中：基金申购款	206,122,415.81	28,982,526.53	235,104,942.34

基金赎回款	-232,456,654.02	-35,551,259.59	-268,007,913.61
本期已分配利润	-3,131,880.02	-	-3,131,880.02
本期末	347,576,961.75	67,275,722.93	414,852,684.68

博时沪深 300 指数 R

无余额

博时沪深 300 指数 Y

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,842,010.97	-3,772,041.97	9,069,969.00
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	12,842,010.97	-3,772,041.97	9,069,969.00
本期利润	1,858,331.68	1,032,772.15	2,891,103.83
本期基金份额交易产生的变动数	8,154,153.98	-2,383,952.56	5,770,201.42
其中：基金申购款	13,153,183.76	-3,722,768.44	9,430,415.32
基金赎回款	-4,999,029.78	1,338,815.88	-3,660,213.90
本期已分配利润	-101,314.64	-	-101,314.64
本期末	22,753,181.99	-5,123,222.38	17,629,959.61

博时沪深 300 指数 I

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	133,932.52	-39,708.74	94,223.78
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	133,932.52	-39,708.74	94,223.78

本期利润	15,400.69	29,115.66	44,516.35
本期基金份额交易产生的变动数	118,787.23	-50,554.07	68,233.16
其中：基金申购款	609,986.27	-185,473.72	424,512.55
基金赎回款	-491,199.04	134,919.65	-356,279.39
本期已分配利润	-774.33	-	-774.33
本期末	267,346.11	-61,147.15	206,198.96

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	530,610.54
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,795.76
其他	1,544.85
合计	540,951.15

6.4.6.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	4,538,761,534.21
减：卖出股票成本总额	4,206,462,313.88
减：交易费用	4,499,924.83
买卖股票差价收入	327,799,295.50

6.4.6.11 债券投资收益

6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	136,294.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	136,294.65

6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

6.4.6.12 资产支持证券投资收益

6.4.6.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.6.13 衍生工具收益

6.4.6.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.6.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.6.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	54,495,309.87
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	54,495,309.87

6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	170,069,871.53
——股票投资	170,053,628.53
——债券投资	16,243.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	170,069,871.53

6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	596,002.68
基金转换费收入	50,902.91
合计	646,905.59

6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	628.61
银行汇划费	12,649.59
中债登账户维护费	9,000.00
合计	126,416.55

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方、关联关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	25,817,368.21	29,340,531.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,488,252.82	7,390,726.01
应支付基金管理人的净管理费	19,329,115.39	21,949,805.68

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日 A 类基金份额、C 类基金份额、R 类基金份额、Y 类基金份额和 I 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额、C 类基金份额、R 类基金份额、Y 类基金份额和 I 类基金份额约定的管理费年费率分别为 0.98%、0.98%、0.98%、0.49% 和 0.98%。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日 A/C/R/Y/I 类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,268,850.63	5,987,863.64

注：支付基金托管人的托管费按前一日 A 类基金份额、C 类基金份额、R 类基金份额、Y 类基金份额和 I 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额、C 类基金份额、R 类基金份额、Y 类基金份额和 I 类基金份额约定的托管费年费率分别为 0.20%、0.20%、0.20%、0.10% 和 0.20%。其计算公式为：

日托管费 = 前一日 A/C/R/Y/I 类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服 务费的各关 联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费					
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I	合计
招商证券	-	270.83	-	-	-	270.83
博时基金	-	47,018.99	-	-	152.60	47,171.59

博时财富	-	50.44	-	-	-	50.44
合计	-	47,340.26	-	-	152.60	47,492.86
获得销售服 务费的各关 联方名称	上年度可比期间					
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
	当期发生的基金应支付的销售服务费					
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I	合计
招商证券	-	995.28	-	-	-	995.28
博时基金	-	55,081.89	-	-	6.71	55,088.60
博时财富	-	195.54	-	-	-	195.54
合计	-	56,272.71	-	-	6.71	56,279.42

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额和 I 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额和 I 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.40% 和 0.10%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C/I 类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.9.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.9.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.9.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.9.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.9.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30	
	30 日		日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	124,557,541.84	530,610.54	367,167,979.24	646,929.98

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	920186	中科仪	北交所网下新股中签	7,200.00	116,712.00
招商证券股份有限公司	001365	天海电子	网下发行	2,394.00	65,092.86
上年度可比期间					
2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	001388	信通电子	网下发行	937.00	15,385.54

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 利润分配情况

博时沪深 300 指数 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2026-01-13	-	2026-01-13	0.0980	14,246,903.79	8,978,210.52	23,225,114.31	-
合计				0.0980	14,246,903.79	8,978,210.52	23,225,114.31	-

博时沪深 300 指数 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2026-01-13	-	2026-01-13	0.0810	2,100,218.95	1,031,661.07	3,131,880.02	-
合计				0.0810	2,100,218.95	1,031,661.07	3,131,880.02	-

博时沪深 300 指数 R

无。

博时沪深 300 指数 Y

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2026-01-13	-	2026-01-13	0.0990	-	101,314.64	101,314.64	-
合计				0.0990	-	101,314.64	101,314.64	-

博时沪深 300 指数 I

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	利润 分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026-01-13	-	2026-01-13	0.0980	774.33	-	774.33	-
合计				0.0980	774.33	-	774.33	-

6.4.11 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成功 认购日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备 注
300750	宁德时代	2026-04-24	6个月	非公开发 行限售	410.34	373.17	347,000.00	142,387,980.00	129,489,990.00	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9个月	首次公 开发行 限售	104.66	768.89	3,994.00	418,012.04	3,070,946.66	-

001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	首次公开发行限售	10.11	10.11	58,873.00	595,206.03	595,206.03	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	首次公开发行限售	46.08	463.33	1,220.00	56,217.60	565,262.60	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	首次公开发行限售	19.68	141.49	2,391.00	47,054.88	338,302.59	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	首次公开发行限售	22.68	42.16	6,335.00	143,677.80	267,083.60	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	首次公开发行限售	81.88	1,584.33	163.00	13,346.44	258,245.79	-
001248	华润新能	2026-06-24	6 个交易日	新股未上	10.11	10.11	25,231.00	255,085.41	255,085.41	-

	源		日	市						
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	首次公开发行限售	10.12	27.73	6,488.00	65,658.56	179,912.24	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	首次公开发行限售	9.47	70.14	1,717.00	16,259.99	120,430.38	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	首次公开发行限售	69.66	160.06	714.00	49,737.24	114,282.84	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	首次公开发行限售	44.56	468.67	207.00	9,223.92	97,014.69	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	首次公开发行限售	17.52	35.92	1,500.00	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	首次公	92.18	463.15	116.00	10,692.88	53,725.40	-

				开 发 行 限 售						
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	首次公开发 行限售	26.28	172.09	234.00	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	首次公开发 行限售	40.98	308.19	128.00	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	首次公开发 行限售	7.82	20.74	1,743.00	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	首次公开发 行限售	17.70	84.32	330.00	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	首次公开发 行限	27.19	31.31	719.00	19,549.61	22,511.89	-

				售						
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	首次公开发行限售	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	首次公开发行限售	24.68	86.80	216.00	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	首次公开发行限售	53.26	58.74	285.00	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026-06-02	6个月	首次公开发行限售	7.08	28.40	546.00	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	首次公开发行限售	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月	首次公	30.38	38.99	387.00	11,757.06	15,089.13	-

				开 发 行 限 售						
30153 1	春 光 集 团	2026-04-2 8	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	13.30	51.56	290.00	3,857.00	14,952.40	-
30159 9	理 奇 智 能	2026-04-2 2	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	13.91	32.47	433.00	6,023.03	14,059.51	-
60111 2	振 石 股 份	2026-01-2 1	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	11.18	17.59	775.00	8,664.50	13,632.25	-
30168 0	固 德 电 材	2026-02-2 7	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	58.00	112.16	117.00	6,786.00	13,122.72	-
30168 3	慧 谷 新 材	2026-03-2 4	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限	78.38	121.77	96.00	7,524.48	11,689.92	-

				售						
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	首次公开发行限售	55.95	57.10	177.00	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	首次公开发行限售	13.86	73.46	137.00	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	首次公开发行限售	26.66	50.96	138.00	3,679.08	7,032.48	-
920136	永励精密	2026-06-25	10 个交易日	新股未上市	19.28	19.28	300.00	5,784.00	5,784.00	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	首次公开发行限售	15.76	46.71	104.00	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	首次公开发	21.88	25.52	112.00	2,450.56	2,858.24	-

				行 限 售						
92019 3	吉 和 昌	2026-06-1 8	9 个 交 易 日	新 股 未 上 市	8.52	8.52	300.00	2,556.00	2,556.00	-
60329 3	埃 泰 克	2026-04-0 9	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	33.49	33.93	72.00	2,411.28	2,442.96	-
00131 2	福 恩 股 份	2026-04-1 4	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	18.38	16.78	134.00	2,462.92	2,248.52	-
60328 4	林 平 发 展	2026-02-0 3	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	37.88	34.87	46.00	1,742.48	1,604.02	-
00122 0	世 盟 股 份	2026-01-2 7	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	28.00	27.78	57.00	1,596.00	1,583.46	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自

发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备 注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	28,500.00	17,683,129.38	23,712,000.00	-

注：本基金截至 2026 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金属被动式股票指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括

信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在 95%以上，并保持年跟踪误差在 4%以下的投资目标。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、法律合规部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	201,296,383.56	-
合计	201,296,383.56	-

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	124,557,541.84	-	-	-	124,557,541.84
结算备付金	5,056,398.82	-	-	-	5,056,398.82
存出保证金	360,171.61	-	-	-	360,171.61
交易性金融资产	201,296,383.56	-	-	-5,045,902,802.15	5,247,199,185.71
应收清算款	-	-	-	30,669.72	30,669.72
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,065,728.43	4,065,728.43
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	331,270,495.83	-	-	-5,049,999,200.30	5,381,269,696.13
负债					
卖出回购金融资 产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	16,586,175.34	16,586,175.34
应付清算款	-	-	-	73,815.34	73,815.34
应付管理人报酬	-	-	-	4,165,778.63	4,165,778.63
应付托管费	-	-	-	850,158.81	850,158.81
应付销售服务费	-	-	-	221,845.32	221,845.32
应交税费	-	-	-	4,579.58	4,579.58
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,333,802.06	1,333,802.06
负债总计	-	-	-	23,236,155.08	23,236,155.08
利率敏感度缺口	331,270,495.83	-	-	-5,026,763,045.22	5,358,033,541.05
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	345,808,405.24	-	-	-	345,808,405.24
结算备付金	3,322,994.26	-	-	-	3,322,994.26
存出保证金	390,642.62	-	-	-	390,642.62
交易性金融资产	-	-	-	-5,234,073,806.72	5,234,073,806.72
应收清算款	-	-	-	36,261,457.04	36,261,457.04

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,997,712.10	3,997,712.10
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	349,522,042.12	-	-	-5,274,332,975.86	5,623,855,017.98
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	24,381,907.58	24,381,907.58
应付清算款	-	-	-	36,285,569.69	36,285,569.69
应付管理人报酬	-	-	-	4,620,997.01	4,620,997.01
应付托管费	-	-	-	943,060.65	943,060.65
应付销售服务费	-	-	-	269,196.80	269,196.80
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,528,055.78	1,528,055.78
负债总计	-	-	-	68,028,787.51	68,028,787.51
利率敏感度缺口	349,522,042.12	-	-	-5,206,304,188.35	5,555,826,230.47

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 27	-
	市场利率下降 25 个基点	增加约 27	-

注：上年度末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(不包括可转债和可交换债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外

的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	5,045,902,802.15	94.17	5,234,073,806.72	94.21
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,045,902,802.15	94.17	5,234,073,806.72	94.21

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为 0。

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 28,268	增加约 30,926

	业绩比较基准下降 5%	减少约 28,268	减少约 30,926
--	-------------	------------	------------

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年6月30日
第一层次	4,886,345,257.44
第二层次	225,867,015.00
第三层次	134,986,913.27
合计	5,247,199,185.71

6.4.13.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.13.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.13.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,045,902,802.15	93.77
	其中：股票	5,045,902,802.15	93.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	201,296,383.56	3.74
	其中：债券	201,296,383.56	3.74
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	129,613,940.66	2.41
8	其他各项资产	4,456,569.76	0.08
9	合计	5,381,269,696.13	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	492.80	0.00

B	采矿业	227,739,493.72	4.25
C	制造业	2,764,943,371.43	51.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,113,547.74	1.48
E	建筑业	32,770,934.96	0.61
F	批发和零售业	16,190,281.80	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	60,432,773.70	1.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	235,186,495.43	4.39
J	金融业	861,042,514.02	16.07
K	房地产业	41.67	0.00
L	租赁和商务服务业	37,113,951.48	0.69
M	科学研究和技术服务业	77,039,068.38	1.44
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,391,572,967.13	81.96

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	9,718,265.00	0.18
B	采矿业	1,495,315.63	0.03
C	制造业	416,995,827.51	7.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,939,671.44	0.17

E	建筑业	11,765,324.32	0.22
F	批发和零售业	62,759,478.41	1.17
G	交通运输、仓储和邮政业	11,977,957.46	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,249,219.30	0.53
J	金融业	21,997,731.00	0.41
K	房地产业	42,531,832.95	0.79
L	租赁和商务服务业	5,030,844.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	1,655,400.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	28,196,256.00	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,016,712.00	0.06
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	654,329,835.02	12.21

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	212,780	270,230,600.00	5.04
2	300750	宁德时代	533,482	202,779,280.82	3.78
3	300502	新易盛	261,480	158,718,360.00	2.96
4	600519	贵州茅台	124,425	147,504,593.25	2.75
5	603986	兆易创新	143,110	116,634,650.00	2.18
6	688256	寒武纪	58,371	93,133,849.05	1.74
7	601318	中国平安	1,941,892	92,705,924.08	1.73

8	000333	美的集团	1,172,274	88,541,855.22	1.65
9	601899	紫金矿业	3,345,816	84,113,814.24	1.57
10	600030	中信证券	2,870,843	82,479,319.39	1.54
11	603259	药明康德	618,738	77,039,068.38	1.44
12	600036	招商银行	2,047,900	72,700,450.00	1.36
13	600900	长江电力	2,645,690	70,031,414.30	1.31
14	601138	工业富联	940,808	67,879,297.20	1.27
15	601211	国泰海通	3,557,636	64,748,975.20	1.21
16	002384	东山精密	241,600	63,383,760.00	1.18
17	002475	立讯精密	847,053	59,632,531.20	1.11
18	688008	澜起科技	191,560	59,364,444.00	1.11
19	688012	中微公司	123,607	57,909,879.50	1.08
20	600150	中国船舶	1,641,703	55,473,144.37	1.04
21	600887	伊利股份	2,252,554	53,971,193.84	1.01
22	688041	海光信息	143,110	52,993,633.00	0.99
23	601166	兴业银行	3,090,115	51,172,304.40	0.96
24	002415	海康威视	1,442,208	49,323,513.60	0.92
25	600919	江苏银行	4,539,675	48,937,696.50	0.91
26	601398	工商银行	6,860,300	48,502,321.00	0.91
27	600183	生益科技	269,850	46,791,990.00	0.87
28	000776	广发证券	1,977,900	46,282,860.00	0.86
29	000651	格力电器	1,198,900	44,958,750.00	0.84
30	002463	沪电股份	284,600	43,486,880.00	0.81
31	601328	交通银行	6,698,000	43,068,140.00	0.80
32	688981	中芯国际	255,900	40,642,038.00	0.76
33	002371	北方华创	43,472	38,453,592.32	0.72
34	601995	中金公司	1,062,600	38,412,990.00	0.72
35	300408	三环集团	230,000	38,387,000.00	0.72
36	600015	华夏银行	5,855,900	37,419,201.00	0.70
37	000725	京东方 A	4,204,060	36,491,240.80	0.68
38	300394	天孚通信	118,755	35,944,763.40	0.67
39	000792	盐湖股份	1,152,400	34,790,956.00	0.65
40	000938	紫光股份	1,196,500	34,530,990.00	0.64
41	301308	江波龙	48,364	34,038,583.20	0.64
42	300476	胜宏科技	95,800	33,187,994.00	0.62
43	000538	云南白药	683,240	32,365,078.80	0.60
44	600019	宝钢股份	5,885,800	31,959,894.00	0.60
45	688111	金山办公	146,519	31,215,872.95	0.58
46	600309	万华化学	448,300	30,668,203.00	0.57
47	601688	华泰证券	1,460,600	30,117,572.00	0.56
48	601288	农业银行	4,888,400	29,672,588.00	0.55
49	601857	中国石油	3,414,573	29,638,493.64	0.55
50	603993	洛阳钼业	1,683,300	29,541,915.00	0.55

51	600176	中国巨石	401,564	29,265,984.32	0.55
52	601066	中信建投	961,600	27,953,712.00	0.52
53	300274	阳光电源	174,600	27,764,892.00	0.52
54	000338	潍柴动力	992,304	27,040,284.00	0.50
55	002027	分众传媒	5,549,400	26,859,096.00	0.50
56	000895	双汇发展	1,157,700	25,932,480.00	0.48
57	600522	中天科技	425,200	25,801,136.00	0.48
58	603019	中科曙光	235,500	25,252,665.00	0.47
59	601088	中国神华	637,600	24,891,904.00	0.46
60	300033	同花顺	101,855	24,547,055.00	0.46
61	601766	中国中车	4,648,655	24,173,006.00	0.45
62	688072	拓荆科技	28,500	23,712,000.00	0.44
63	000001	平安银行	2,277,300	22,886,865.00	0.43
64	002142	宁波银行	766,470	22,756,494.30	0.42
65	600741	华域汽车	1,436,724	22,297,956.48	0.42
66	002916	深南电路	46,860	21,457,194.00	0.40
67	300014	亿纬锂能	323,719	21,051,446.57	0.39
68	000988	华工科技	111,800	20,639,398.00	0.39
69	000408	藏格矿业	290,400	20,130,528.00	0.38
70	688521	芯原股份	53,900	20,004,446.00	0.37
71	601225	陕西煤业	961,800	19,572,630.00	0.37
72	002558	巨人网络	687,000	18,933,720.00	0.35
73	600276	恒瑞医药	360,492	18,760,003.68	0.35
74	300059	东方财富	906,630	18,477,119.40	0.34
75	605117	德业股份	170,900	18,146,162.00	0.34
76	000100	TCL 科技	3,104,060	18,065,629.20	0.34
77	601877	正泰电器	719,000	18,025,330.00	0.34
78	601816	京沪高铁	3,959,800	17,937,894.00	0.33
79	002709	天赐材料	342,700	17,625,061.00	0.33
80	600406	国电南瑞	769,700	17,587,645.00	0.33
81	600938	中国海油	636,400	17,278,260.00	0.32
82	601360	三六零	1,951,900	16,962,011.00	0.32
83	002028	思源电气	97,654	16,894,142.00	0.32
84	601607	上海医药	1,051,317	16,190,281.80	0.30
85	000708	中信特钢	1,269,183	16,017,089.46	0.30
86	601117	中国化学	2,005,100	14,737,485.00	0.28
87	002460	赣锋锂业	212,700	13,910,580.00	0.26
88	601668	中国建筑	3,190,574	13,847,091.16	0.26
89	600089	特变电工	601,629	13,536,652.50	0.25
90	601601	中国太保	453,830	12,943,231.60	0.24
91	601872	招商轮船	723,900	12,718,923.00	0.24
92	000807	云铝股份	560,900	12,418,326.00	0.23
93	000657	中钨高新	127,600	12,213,872.00	0.23

94	002602	世纪华通	858,500	12,104,850.00	0.23
95	600989	宝丰能源	585,600	11,905,248.00	0.22
96	600372	中航机载	1,074,200	11,655,070.00	0.22
97	601988	中国银行	2,009,500	11,494,340.00	0.21
98	002230	科大讯飞	280,500	11,455,620.00	0.21
99	600104	上汽集团	1,161,100	11,332,336.00	0.21
100	002236	大华股份	671,700	11,076,333.00	0.21
101	600489	中金黄金	564,600	10,191,030.00	0.19
102	600584	长电科技	97,900	10,137,545.00	0.19
103	600028	中国石化	2,176,300	9,706,298.00	0.18
104	600031	三一重工	557,400	9,631,872.00	0.18
105	600660	福耀玻璃	186,600	9,412,104.00	0.18
106	300442	润泽科技	110,165	9,151,406.55	0.17
107	600549	厦门钨业	105,850	9,018,420.00	0.17
108	600233	圆通速递	560,200	8,823,150.00	0.16
109	601919	中远海控	651,411	8,637,709.86	0.16
110	002001	新和成	302,604	8,600,005.68	0.16
111	002202	金风科技	343,600	8,212,040.00	0.15
112	600000	浦发银行	940,486	8,097,584.46	0.15
113	002353	杰瑞股份	50,000	7,625,000.00	0.14
114	601998	中信银行	1,026,200	7,111,566.00	0.13
115	603799	华友钴业	143,500	6,925,310.00	0.13
116	300999	金龙鱼	294,909	6,859,583.34	0.13
117	002648	卫星化学	269,900	6,339,951.00	0.12
118	601009	南京银行	634,169	6,271,931.41	0.12
119	000630	铜陵有色	970,200	6,170,472.00	0.12
120	000999	华润三九	274,310	6,169,231.90	0.12
121	601658	邮储银行	1,163,300	5,735,069.00	0.11
122	601600	中国铝业	674,400	5,543,568.00	0.10
123	688183	生益电子	41,077	5,438,594.80	0.10
124	600415	小商品城	518,228	5,265,196.48	0.10
125	002050	三花智控	119,200	5,224,536.00	0.10
126	002311	海大集团	115,500	5,152,455.00	0.10
127	600016	民生银行	1,596,509	5,140,758.98	0.10
128	601888	中国中免	92,900	4,989,659.00	0.09
129	603296	华勤技术	66,200	4,916,674.00	0.09
130	002594	比亚迪	59,211	4,719,116.70	0.09
131	603288	海天味业	135,100	4,479,916.00	0.08
132	600029	南方航空	817,900	4,236,722.00	0.08
133	002466	天齐锂业	68,400	4,194,288.00	0.08
134	600039	四川路桥	535,340	4,186,358.80	0.08
135	601111	中国国航	618,500	3,741,925.00	0.07
136	002625	光启技术	120,200	3,644,464.00	0.07

137	600011	华能国际	466,100	3,537,699.00	0.07
138	300628	亿联网络	100,900	3,412,438.00	0.06
139	600795	国电电力	716,332	3,345,270.44	0.06
140	300124	汇川技术	50,126	3,324,857.58	0.06
141	600941	中国移动	38,500	3,316,005.00	0.06
142	600188	兖矿能源	157,858	2,805,136.66	0.05
143	600018	上港集团	594,147	2,804,373.84	0.05
144	000063	中兴通讯	71,797	2,598,333.43	0.05
145	600118	中国卫星	28,100	2,305,605.00	0.04
146	605499	东鹏饮料	16,481	2,034,249.83	0.04
147	600809	山西汾酒	16,200	1,771,794.00	0.03
148	600875	东方电气	59,900	1,723,323.00	0.03
149	600066	宇通客车	62,200	1,667,582.00	0.03
150	600026	中远海能	85,400	1,532,076.00	0.03
151	300450	先导智能	36,800	1,498,496.00	0.03
152	000858	五粮液	20,000	1,480,000.00	0.03
153	600690	海尔智家	71,400	1,457,274.00	0.03
154	601169	北京银行	286,800	1,405,320.00	0.03
155	600362	江西铜业	32,100	1,389,930.00	0.03
156	600050	中国联通	330,200	1,320,800.00	0.02
157	002049	紫光国微	14,300	1,269,125.00	0.02
158	600025	华能水电	127,700	1,135,253.00	0.02
159	003816	中国广核	272,100	1,063,911.00	0.02
160	688396	华润微	10,400	1,014,520.00	0.02
161	000568	泸州老窖	10,893	844,425.36	0.02
162	601127	赛力斯	13,500	826,875.00	0.02
163	600460	士兰微	11,000	601,260.00	0.01
164	002532	天山铝业	14,800	158,804.00	0.00
165	300661	圣邦股份	40	5,739.20	0.00
166	000596	古井贡酒	50	3,990.00	0.00
167	601628	中国人寿	23	813.05	0.00
168	300498	温氏股份	40	492.80	0.00
169	601728	中国电信	52	269.88	0.00
170	601818	光大银行	69	199.41	0.00
171	601229	上海银行	13	112.84	0.00
172	603392	万泰生物	4	107.88	0.00
173	600048	保利发展	9	41.67	0.00
174	601898	中煤能源	1	12.18	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比
----	------	------	-------	------	----------

					例(%)
1	002414	高德红外	2,059,042.00	27,302,896.92	0.51
2	600323	瀚蓝环境	701,600.00	19,265,936.00	0.36
3	688002	睿创微纳	117,537.00	18,181,798.53	0.34
4	300590	移为通信	1,179,500.00	16,925,825.00	0.32
5	603444	吉比特	46,900.00	16,809,898.00	0.31
6	300857	协创数据	44,980.00	15,288,702.00	0.29
7	002271	东方雨虹	1,278,800.00	15,179,356.00	0.28
8	300475	香农芯创	46,600.00	13,980,000.00	0.26
9	600007	中国国贸	732,700.00	13,906,646.00	0.26
10	688525	佰维存储	27,100.00	13,407,183.00	0.25
11	002299	圣农发展	861,200.00	13,055,792.00	0.24
12	600064	南京高科	1,804,948.00	12,869,279.24	0.24
13	000951	中国重汽	617,900.00	12,055,229.00	0.22
14	688498	源杰科技	6,020.00	11,353,720.00	0.21
15	002111	威海广泰	1,256,800.00	11,311,200.00	0.21
16	603317	天味食品	859,500.00	11,182,095.00	0.21
17	300604	长川科技	31,100.00	10,618,162.00	0.20
18	001309	德明利	11,100.00	10,466,190.00	0.20
19	000933	神火股份	485,600.00	10,294,720.00	0.19
20	688766	普冉股份	12,700.00	9,735,820.00	0.18
21	688578	艾力斯	87,300.00	9,533,160.00	0.18
22	603233	大参林	622,600.00	9,357,678.00	0.17
23	601061	中信金属	841,700.00	9,065,109.00	0.17
24	600998	九州通	1,865,000.00	8,746,850.00	0.16
25	600801	华新建材	553,500.00	8,634,600.00	0.16
26	002517	恺英网络	508,400.00	8,261,500.00	0.15
27	000783	长江证券	791,600.00	7,718,100.00	0.14
28	600598	北大荒	705,200.00	7,644,368.00	0.14
29	688503	聚和材料	57,000.00	7,563,900.00	0.14
30	300438	鹏辉能源	90,000.00	7,456,500.00	0.14
31	001914	招商积余	878,801.00	7,171,016.16	0.13
32	300972	万辰集团	40,801.00	7,075,301.41	0.13
33	301607	富特科技	134,904.00	7,048,734.00	0.13
34	601108	财通证券	814,400.00	7,044,560.00	0.13
35	301358	湖南裕能	92,500.00	7,017,975.00	0.13
36	601886	江河集团	833,744.00	6,694,964.32	0.12
37	300223	北京君正	26,500.00	6,595,850.00	0.12
38	002557	洽洽食品	362,400.00	6,508,704.00	0.12
39	000800	一汽解放	1,072,000.00	6,378,400.00	0.12
40	300681	英搏尔	222,800.00	6,376,536.00	0.12
41	600685	中船防务	248,800.00	6,329,472.00	0.12
42	600428	中远海特	789,800.00	6,168,338.00	0.12

43	600927	永安期货	472,300.00	5,880,135.00	0.11
44	601156	东航物流	360,300.00	5,808,036.00	0.11
45	002416	爱施德	608,800.00	5,454,848.00	0.10
46	603345	安井食品	67,900.00	5,444,901.00	0.10
47	688266	泽璟制药	44,900.00	5,238,034.00	0.10
48	605599	菜百股份	381,600.00	5,227,920.00	0.10
49	600502	安徽建工	1,165,600.00	5,070,360.00	0.09
50	688297	中无人机	120,100.00	4,990,155.00	0.09
51	002653	海思科	73,700.00	4,889,258.00	0.09
52	000036	华联控股	1,105,900.00	4,832,783.00	0.09
53	300073	当升科技	98,200.00	4,717,528.00	0.09
54	603588	高能环境	237,800.00	4,565,760.00	0.09
55	688127	蓝特光学	46,500.00	4,538,400.00	0.08
56	688559	海目星	54,000.00	4,531,680.00	0.08
57	001286	陕西能源	439,500.00	4,456,530.00	0.08
58	688155	先惠技术	54,400.00	4,400,416.00	0.08
59	301536	星宸科技	32,100.00	4,131,591.00	0.08
60	301345	涛涛车业	16,400.00	3,788,400.00	0.07
61	002033	丽江股份	446,800.00	3,690,568.00	0.07
62	688630	芯碁微装	6,600.00	3,625,974.00	0.07
63	688059	华锐精密	18,000.00	3,594,780.00	0.07
64	688110	东芯股份	16,000.00	3,259,200.00	0.06
65	002043	兔宝宝	288,500.00	3,196,580.00	0.06
66	600755	厦门国贸	587,700.00	3,185,334.00	0.06
67	002487	大金重工	54,800.00	3,176,756.00	0.06
68	688802	沐曦股份	3,994.00	3,070,946.66	0.06
69	003010	若羽臣	125,700.00	3,054,510.00	0.06
70	605098	行动教育	55,700.00	3,016,712.00	0.06
71	688779	五矿新能	366,800.00	2,974,748.00	0.06
72	300432	富临精工	147,600.00	2,965,284.00	0.06
73	688208	道通科技	115,900.00	2,919,521.00	0.05
74	600487	亨通光电	25,700.00	2,810,038.00	0.05
75	300735	光弘科技	118,400.00	2,692,416.00	0.05
76	301200	大族数控	7,300.00	2,632,745.00	0.05
77	300919	中伟新材	56,400.00	2,467,500.00	0.05
78	603268	松发股份	16,200.00	2,256,336.00	0.04
79	000062	深圳华强	70,900.00	2,256,038.00	0.04
80	001389	广合科技	9,500.00	2,253,875.00	0.04
81	300573	兴齐眼药	53,356.00	2,174,790.56	0.04
82	600132	重庆啤酒	51,400.00	2,122,820.00	0.04
83	000778	新兴铸管	542,700.00	2,013,417.00	0.04
84	002458	益生股份	257,700.00	2,002,329.00	0.04
85	688388	嘉元科技	44,190.00	1,944,360.00	0.04

86	002603	以岭药业	127,600.00	1,914,000.00	0.04
87	600057	厦门象屿	340,500.00	1,845,510.00	0.03
88	688257	新锐股份	17,900.00	1,824,010.00	0.03
89	300042	朗科科技	23,700.00	1,805,229.00	0.03
90	600641	先导基电	42,700.00	1,702,022.00	0.03
91	688372	伟测科技	8,900.00	1,655,400.00	0.03
92	301377	鼎泰高科	3,000.00	1,652,700.00	0.03
93	688778	厦钨新能	29,300.00	1,593,920.00	0.03
94	002746	仙坛股份	312,300.00	1,592,730.00	0.03
95	600639	浦东金桥	174,300.00	1,589,616.00	0.03
96	603061	金海通	3,100.00	1,556,882.00	0.03
97	000685	中山公用	138,100.00	1,541,196.00	0.03
98	002039	黔源电力	79,800.00	1,501,836.00	0.03
99	600546	山煤国际	133,500.00	1,459,155.00	0.03
100	300037	新宙邦	15,500.00	1,439,175.00	0.03
101	300953	震裕科技	10,740.00	1,435,938.00	0.03
102	002008	大族激光	9,300.00	1,396,023.00	0.03
103	688275	万润新能	10,900.00	1,390,295.00	0.03
104	002961	瑞达期货	69,200.00	1,354,936.00	0.03
105	600332	白云山	62,800.00	1,258,512.00	0.02
106	688629	华丰科技	6,700.00	1,256,317.00	0.02
107	002701	奥瑞金	293,929.00	1,252,137.54	0.02
108	000519	中兵红箭	47,800.00	1,007,146.00	0.02
109	301031	中熔电气	8,352.00	997,646.40	0.02
110	600572	康恩贝	231,600.00	907,872.00	0.02
111	300975	商络电子	17,400.00	900,450.00	0.02
112	001248	华润新能源	84,104.00	850,291.44	0.02
113	001218	丽臣实业	38,200.00	842,692.00	0.02
114	603638	艾迪精密	30,300.00	710,535.00	0.01
115	000550	江铃汽车	42,300.00	686,106.00	0.01
116	002266	浙富控股	133,200.00	673,992.00	0.01
117	002345	潮宏基	71,900.00	659,323.00	0.01
118	600098	广州发展	99,800.00	589,818.00	0.01
119	301666	大普微	1,220.00	565,262.60	0.01
120	301606	绿联科技	8,600.00	524,772.00	0.01
121	688221	前沿生物	21,800.00	488,320.00	0.01
122	002091	江苏国泰	67,300.00	486,579.00	0.01
123	600266	城建发展	117,600.00	459,816.00	0.01
124	001339	智微智能	3,600.00	368,208.00	0.01
125	300769	德方纳米	5,200.00	345,800.00	0.01
126	688599	天合光能	24,300.00	343,116.00	0.01
127	688820	盛合晶微	2,391.00	338,302.59	0.01
128	688781	视涯科技	6,335.00	267,083.60	0.00

129	002151	北斗星通	8,200.00	260,350.00	0.00
130	688808	联讯仪器	163.00	258,245.79	0.00
131	688308	欧科亿	1,200.00	218,172.00	0.00
132	688627	精智达	300.00	214,500.00	0.00
133	001287	中电港	6,700.00	208,705.00	0.00
134	001399	惠科股份	6,488.00	179,912.24	0.00
135	688818	电科蓝天	1,717.00	120,430.38	0.00
136	688188	柏楚电子	1,120.00	119,504.00	0.00
137	301682	宏明电子	714.00	114,282.84	0.00
138	688797	臻宝科技	207.00	97,014.69	0.00
139	002772	众兴菌业	6,300.00	71,568.00	0.00
140	688712	北芯生命	1,500.00	53,880.00	0.00
141	688785	恒运昌	116.00	53,725.40	0.00
142	688813	泰金新能	234.00	40,269.06	0.00
143	688635	长进光子	128.00	39,448.32	0.00
144	001257	盛龙股份	1,743.00	36,149.82	0.00
145	603459	红板科技	330.00	27,825.60	0.00
146	002281	光迅科技	89.00	22,867.66	0.00
147	001365	天海电子	719.00	22,511.89	0.00
148	688811	有研复材	834.00	20,124.42	0.00
149	301696	三瑞智能	216.00	18,748.80	0.00
150	001237	惠康科技	285.00	16,740.90	0.00
151	301669	高特电子	546.00	15,506.40	0.00
152	301687	新广益	195.00	15,167.10	0.00
153	001393	维通利	387.00	15,089.13	0.00
154	301531	春光集团	290.00	14,952.40	0.00
155	301599	理奇智能	433.00	14,059.51	0.00
156	601112	振石股份	775.00	13,632.25	0.00
157	301680	固德电材	117.00	13,122.72	0.00
158	301683	慧谷新材	96.00	11,689.92	0.00
159	688816	易思维	177.00	10,106.70	0.00
160	603407	长裕集团	137.00	10,064.02	0.00
161	301513	尚水智能	138.00	7,032.48	0.00
162	920136	永励精密	300.00	5,784.00	0.00
163	603435	嘉德利	104.00	4,857.84	0.00
164	600378	昊华科技	52.00	3,919.76	0.00
165	688099	晶晨股份	37.00	3,807.30	0.00
166	603352	至信股份	112.00	2,858.24	0.00
167	920193	吉和昌	300.00	2,556.00	0.00
168	603293	埃泰克	72.00	2,442.96	0.00
169	001312	福恩股份	134.00	2,248.52	0.00
170	688169	石头科技	20.00	1,899.40	0.00
171	603284	林平发展	46.00	1,604.02	0.00

172	001220	世盟股份	57.00	1,583.46	0.00
173	603195	公牛集团	40.00	1,566.00	0.00
174	688612	威迈斯	33.00	976.47	0.00
175	688658	悦康药业	48.00	617.28	0.00
176	600663	陆家嘴	85.00	533.80	0.00
177	600649	城投控股	35.00	120.75	0.00
178	601808	中海油服	1.00	10.81	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	163,287,824.00	2.94
2	600030	中信证券	82,671,205.70	1.49
3	000651	格力电器	51,638,531.93	0.93
4	600900	长江电力	48,605,281.99	0.87
5	600015	华夏银行	44,840,348.00	0.81
6	000776	广发证券	43,195,407.75	0.78
7	688111	金山办公	39,833,072.76	0.72
8	601995	中金公司	39,573,317.00	0.71
9	002371	北方华创	39,514,582.00	0.71
10	600309	万华化学	39,489,879.00	0.71
11	600519	贵州茅台	38,687,083.78	0.70
12	000538	云南白药	37,795,848.25	0.68
13	002736	国信证券	34,226,612.00	0.62
14	002384	东山精密	32,439,024.94	0.58
15	600150	中国船舶	31,929,703.51	0.57
16	000999	华润三九	31,828,803.00	0.57
17	000568	泸州老窖	29,936,643.83	0.54
18	601006	大秦铁路	29,350,600.00	0.53
19	600036	招商银行	28,940,082.00	0.52
20	600741	华域汽车	28,663,748.81	0.52

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	300750	宁德时代	189,815,788.13	3.42
2	600030	中信证券	59,825,935.00	1.08
3	600989	宝丰能源	53,175,419.15	0.96
4	300308	中际旭创	48,726,937.00	0.88
5	601166	兴业银行	47,655,613.00	0.86
6	601628	中国人寿	46,042,876.00	0.83
7	601336	新华保险	45,243,300.00	0.81
8	000783	长江证券	45,000,348.00	0.81
9	001337	四川黄金	43,128,565.59	0.78
10	600690	海尔智家	42,779,236.00	0.77
11	300442	润泽科技	41,614,769.97	0.75
12	601899	紫金矿业	41,122,218.00	0.74
13	002736	国信证券	40,129,344.00	0.72
14	600150	中国船舶	38,861,818.53	0.70
15	000938	紫光股份	38,699,373.00	0.70
16	600406	国电南瑞	38,636,945.00	0.70
17	002142	宁波银行	38,327,841.90	0.69
18	601857	中国石油	38,246,921.60	0.69
19	600867	通化东宝	38,192,671.42	0.69
20	601901	方正证券	37,809,452.00	0.68

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,848,237,680.78
卖出股票的收入（成交）总额	4,538,761,534.21

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	201,296,383.56	3.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	201,296,383.56	3.76

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019827	26 国债 01	2,000,000	201,296,383.56	3.76

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同约定备选股票库之外的股票。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	360,171.61
2	应收清算款	30,669.72
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,065,728.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,456,569.76

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净值 比例(%)	流通受限情况说 明
1	300750	宁德时代	129,489,990.00	2.42	非公开发行限售

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时沪深 300 指数 A	186,025	11,269.57	154,415,323.45	7.37%	1,942,006,429.94	92.63%
博时沪深 300 指数 C	47,288	7,931.56	93,845,027.36	25.02%	281,222,388.66	74.98%
博时沪深 300 指数 R	-	-	-	-	-	-
博时沪深 300 指数 Y	3,843	3,882.44	-	-	14,920,209.23	100.00%
博时沪深 300 指数 I	21	8,471.57	-	-	177,902.87	100.00%
合计	235,555	10,556.29	248,260,350.81	9.98%	2,238,326,930.70	90.02%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时沪深 300 指数 A	964,612.97	0.05%
	博时沪深 300 指数 C	73,911.88	0.02%

	博时沪深 300 指数 R	-	-
	博时沪深 300 指数 Y	35,728.75	0.24%
	博时沪深 300 指数 I	62.50	0.04%
	合计	1,074,316.10	0.04%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时沪深 300 指数 A	10~50
	博时沪深 300 指数 C	-
	博时沪深 300 指数 R	-
	博时沪深 300 指数 Y	0~10
	博时沪深 300 指数 I	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	博时沪深 300 指数 A	-
	博时沪深 300 指数 C	-
	博时沪深 300 指数 R	-
	博时沪深 300 指数 Y	-
	博时沪深 300 指数 I	-
	合计	-

注：本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I
----	---------------	---------------	---------------	---------------	---------------

基金合同生效日 (2003 年 8 月 26 日)基金份额总额	5,126,401,391.87	-	-	-	-
本报告期期初基金份额总额	2,406,524,883.99	409,498,837.25	-	9,212,559.89	97,063.19
本报告期基金总申购份额	181,344,366.43	232,915,674.66	-	9,115,821.23	420,293.10
减:本报告期基金总赎回份额	491,447,497.03	267,347,095.89	-	3,408,171.89	339,453.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-	-
本报告期末基金份额总额	2,096,421,753.39	375,067,416.02	-	14,920,209.23	177,902.87

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2026 年 02 月 14 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张东先生代任公司首席信息官，王德英先生离任公司副总经理、公司首席信息官。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人的相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
财达证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	4	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	1,242,088,637.39	15.07%	255,749.91	15.07%	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-

爱建证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	628,710,663.91	7.63%	129,452.00	7.63%	-
方正证券	2	197,943,765.50	2.40%	40,759.60	2.40%	减少 1 个
民生证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	增加 1 个
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	5	417,924,788.87	5.07%	85,935.14	5.06%	增加 1 个
诚通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
国信证券	1	2,367,105,020.11	28.73%	487,440.34	28.72%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	340,103,965.02	4.13%	70,030.98	4.13%	减少 1 个
第一创业	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	252,026,045.69	3.06%	51,893.94	3.06%	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	1,373,020,831.79	16.66%	282,946.30	16.67%	-
中泰证券	2	502,048,822.41	6.09%	103,453.72	6.10%	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
东方证券	3	919,484,154.10	11.16%	189,331.80	11.16%	-

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序

(1) 本公司根据法规要求制定《博时基金公募基金证券交易佣金分配管理办法》，明确选择证券公司参与证券交易的标准和程序，并建立证券公司的准入管理机制，符合筛选标准的证券公司可纳入公司证券公司白名单库，并持续动态管理。

(2) 本公司选择证券公司参与证券交易的主要标准是财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。严禁基金销售业务人员参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

(3) 本公司依据上述标准进行评估并确定证券公司，与其签订交易单元租用协议或证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期回 购成交总 额的比例	成交金额	占当期权 证成交总 额的比例
财达证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	200,163,757.00	100.00%	117,600,000.00	100.00%	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 A）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
2	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 Y）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
3	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 I）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
4	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 C）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
5	博时基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-29
6	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-13
7	2025 年度博时基金以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-30
8	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-28
9	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-24
10	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-22
11	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
12	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2025 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31

		露网站	
13	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-26
14	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-14
15	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20260124	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-24
16	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-22
17	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金分红公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-09
18	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-08

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时裕富沪深 300 指数证券投资基金设立的文件
- 2、《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》
- 3、《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金各年度审计报告正本

6、报告期内博时裕富沪深 300 指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日